嘉实医药健康股票型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2018年08月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实医药健康股票型证券投资基金
基金简称	嘉实医药健康股票
基金主代码	005303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月4日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,995,192,737.81份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	嘉实医药健康股票 A 嘉实医药健康股票 C
下属分级基金的交易代码	005303 005304
报告期末下属分级基金的份额总额	1,878,590,618.25份 116,602,119.56份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于医药健康企业中具有长期稳定成长性的上市公司,在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将遵循医药健康题材类股票的投资策略,并在此基础上通过自上而下、自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,并将具有估值优势的港股纳入,构建股票投资组合。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×70%+恒生医疗保健指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票,将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡鹏钦	田青
	联系电话	(010)65215588	(010)67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010)67595096
传真		(010)65215588	(010)66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦16层嘉实基金管理有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	嘉实医药健康股票 A	嘉实医药健康股票 C
本期已实现收益	94,792,343.18	4,751,565.44
本期利润	272,364,991.57	8,351,450.89
加权平均基金份额本期利润	0.0910	0.0641
本期加权平均净值利润率	8.82%	6.20%
本期基金份额净值增长率	7.57%	7.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	93,334,997.16	5,044,995.18
期末可供分配基金份额利润	0.0497	0.0433
期末基金资产净值	2,023,693,290.05	124,868,120.78
期末基金份额净值	1.0772	1.0709
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.72%	7.09%

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)嘉实医药健康股票A收取认(申)购费和赎回费,嘉实医药健康股票C不收取认(申)购费但收取赎回费、计提销售服务费。(3)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;(4) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实医药健康股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.91%	1.96%	-6.46%	1.47%	1.55%	0.49%
过去三个月	2.64%	1.65%	0.26%	1.27%	2.38%	0.38%
过去六个月	7.57%	1.40%	7.79%	1.22%	-0.22%	0.18%
自基金合同生效起至今	7.72%	1.29%	10.90%	1.16%	-3.18%	0.13%

嘉实医药健康股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.94%	1.96%	-6.46%	1.47%	1.52%	0.49%
过去三个月	2.37%	1.65%	0.26%	1.27%	2.11%	0.38%
过去六个月	7.00%	1.40%	7.79%	1.22%	-0.79%	0.18%
自基金合同生效起至今	7.09%	1.29%	10.90%	1.16%	-3.81%	0.13%

注:本基金业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率×70%+恒生医疗保健指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×20%

本基金股票部分主要投资于医药健康主题企业股票。中证医药卫生指数反映沪深A 股中医药健康主题公司股票的整体表现,对医药健康主题企业股票具有较强的代表性, 恒生医疗保健指数反映恒生综合指数里主要经营医疗保健业务成份股公司的表现,两者适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。固定收益部分的业绩比较基准则采用能够较好的反映债券市场整体变动状况的中债综合财富指数收益率。基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=70%*(中证医药卫生指数(t)/ 中证医药卫生指数(t-1)-1)+10%*(恒生医疗保健指数(t)/ 恒生医疗保健指数(t-1)-1)+ 20%*(中债综合财富指数(t)/ 中债综合财富指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return(t))*Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,…。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

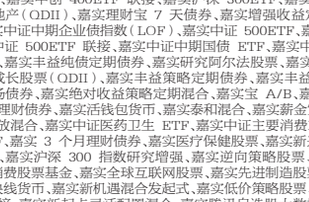

图1:嘉实医药健康股票A基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年12月4日至2018年6月30日)

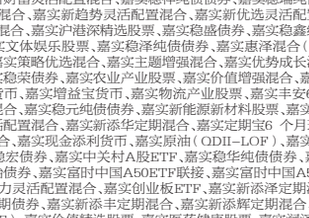

图2:嘉实医药健康股票C基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年12月4日至2018年6月30日)

注:1:本基金基金合同生效日2017年12月4日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

2:2018年4月12日, 本基金管理人发布 《关于基金经理恢复履行职务的公告》,本基金基金经理颜媛女士自2018年4月12日起恢复履行基金经理职务。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII,特定资产管理业务资格。

截止2018年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、142只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300 ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金(QDII-ETF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快钱货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合(LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
颜媛	本基金基金经理	2017年12月4日	-	9年	2008年7月至2009年8月,任泰康资产管理有限公司,担任行业研究员,2008年9月加入嘉实基金,历任研究部研究员,研究部消费组组长。
陈少平	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实新收益混合、嘉实研究增强混合基金经理	2017年12月4日	-	15年	曾任海同投资咨询公司研究员、泰达宏利基金管理公司研究部总监、基金经理。2014年9月加入嘉实基金管理有限公司,现任股票投资业务部研究部CIO,研究总监。硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)基金经理陈少平、颜媛任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定;(3)本基金基金经理颜媛女士因休产假超过30日,在其休假期间,由本公司基金经理陈少平女士代为履行基金经理职责。该事项已于2017年12月21日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露;(4)本基金基金经理颜媛女士已结束休假,自2018年4月12日起恢复履行基金经理职务。该事项已于2018年4月12日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实医药健康股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计4次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年最大的变量因素来自于外部的不确定性,中美贸易摩擦不断升温,加剧了市场的不确定性;同时资管新规落地、信用与广义社融快速收缩,市场在1月份上涨之后即出现了持续的回调,市场风险偏好快速回落。从风格上来看,大市值公司的表现略强于市场,沪深300指数的表现相对跌幅较小,中小板指表现落后于市场。从行业上看,消费行业相对占优,餐饮旅游、医药、食品饮料等行业表现较好,市场呈现出明显的避险情绪;受贸易战影响较大的通讯行业表现落后。报告期内,上证综指下跌13.9%,沪深300下跌12.9%,中小板指数下跌14.26%,创业板指数下跌8.33%,指数大部分的下跌都在二季度完成。医药行业内,生物药和化学制剂板块表现相对较好。

本基金着眼长期,配置受益于行业新周期,符合行业发展趋势的龙头企业。子行业中,超配生物医药、化学制药、药店、医疗服务,配置优质医疗器械的优质公司,低配中药、医药商业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实医药健康股票 A基金份额净值为1.0772元,本报告期基金份额净值增长率为7.57%;截至本报告期末嘉实医药健康股票 C基金份额净值为1.0709元, 本报告期基金份额净值增长率为7.00%;业绩比较基准收益率为7.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年,市场经过二季度的下跌,利空因素得到阶段性充分消化,市场进入长期绝对估值的底部区域,短期看,宏观经济增长与中观景气仍体现出一定韧性,货币政策出现一定的松动,政策组合最负面的阶段可能已经过去,产业资本增持节奏明显加快,市场有可能阶段性有所回暖。但是,中美贸易冲突对国内的宏观经济带来的负面影响会在下半年初步显现,且可能会持续较长的时间,会成为压制市场风险偏好的重要变量。此外,去杠杆的长期性、信用违约以及资管产品整肃带来的流动性冲击仍将继续,市场仍不具备持续上涨的可能。

就医药行业来看,经过2-3年的政策变革,打破了行业的旧格局,重建了新的运行秩序,行业处于长周期的新起点,未来药品将回归治疗的本质,服务将回归医疗的本质。政策带来制药行业的供给侧改革显效,药品疗效和质量优先,研发驱动行业增长,重磅产品陆续获批,仿制药一致性评价也逐步进入收获期,产业集中度提升可期。此外,随着居民人均可支配收入的提升,医疗消费升级趋势不可阻挡。看好创新药和创新器械、高壁垒专科仿制药、专科医疗服务和药店。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所,香港联合交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同(十六(三)基金收益分配原则)约定,报告期内本基金未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:嘉实医药健康股票型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	242,383,779.52	2,518,547,812.76
结算备付金		546,991.38	-
存出保证金		949,668.24	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,925,364,280.25	455,342,599.28
其中:股票投资		1,925,364,280.25	455,342,599.28
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	999,962,099.97
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	47,577.69	1,318,111.62
应收股利		1,350,222.49	-
应收申购款		3,794,848.78	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,174,437,368.35	3,975,190,623.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10,100,595.59	3.80
应付赎回款		10,782,335.45	-
应付管理人报酬		2,686,523.93	4,399,369.62
应付托管费		447,754.00	733,228.26
应付销售服务费		82,899.01	94,076.82
应付交易费用	6.4.7.7	1,566,730.52	315,017.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,119.02	-
负债合计		25,875,957.52	5,541,695.78
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,995,192,737.81	3,964,050,533.49
未分配利润	6.4.7.10	153,368,673.02	5,598,394.36
所有者权益合计		2,148,561,410.83	3,969,648,927.85
负债和所有者权益总计		2,174,437,368.35	3,975,190,623.63

注:报告截止日2018年6月30日,嘉实医药健康股票 A基金份额净值1.0772元,基金份额总额1,878,590,618.25份;嘉实医药健康股票 C基金份额净值1.0709元,基金份额总额116,602,119.56份。基金份额总额合计为1,995,192,737.81份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实医药健康股票型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
一、收入		314,680,565.43
1.利息收入		5,044,296.27
其中:存款利息收入	6.4.7.11	4,095,891.35
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		948,404.92
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		122,387,951.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	109,599,044.56
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	12,788,907.22
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	181,172,533.84
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	6,075,783.54
减:二、费用		33,964,122.97
1. 管理人报酬		24,094,216.54
2. 托管费		4,015,702.81
3. 销售服务费		534,338.96
4. 交易费用	6.4.7.18	5,075,510.39
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	244,354.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		280,716,442.46
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		280,716,442.46

注:本基金合同生效日为2017年12月4日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实医药健康股票型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,964,050,533.49	5,598,394.36	3,969,648,927.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	280,716,442.46	280,716,442.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,968,857,795.68	-132,946,163.80	-2,101,803,959.48
其中:1.基金申购款	541,504,268.59	43,044,614.57	584,548,883.16
2.基金赎回款	-2,510,362,064.27	-175,990,778.37	-2,686,352,842.64
四、本期内基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,995,192,737.81	153,368,673.02	2,148,561,410.83

注:本基金合同生效日为2017年12月4日,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1	至6.4财务报表由下列负责人签署:

经雷 王红 张公允
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实医药健康股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2017]1719号《关于准予嘉实医药健康股票型证券投资基金注册的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实医药健康股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,963,058,330.73元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第1018号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实医药健康股票型证券投资基金基金合同》于2017年12月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,964,050,533.49份基金份额,其中认购资金利息折合992,202.76份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《嘉实医药健康股票型证券投资基金基金合同》和《嘉实医药健康股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实医药健康股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他依法发行上市的股票), 内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称"港股通标的股票")、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%,投资于本基金界定的医药健康企业范围内股票不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率×70%+恒生医疗保健指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×20%

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实医药健康股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年6月30日和2017年12月4日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债, 在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金,由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金